

# 国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金

## 2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2020 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

报告期内，本基金管理人对本基金进行了基金份额拆分。本基金管理人按照 1:2 的基金份额拆分比例，对 2020 年 9 月 8 日（权益登记日）登记在册的各基金份额持有人的基金份额进行了拆分，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2020 年 9 月 9 日完成了变更登记。基金份额拆分后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额拆分对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额拆分后，基金份额持有人按照拆分后的基金份额享有权利并承担义务。因基金份额拆分导致基金份额净值变化，不改变基金的风险收益特征，也不降低基金投资的风险或提高基金投资的预期收益。具体可查阅本基金管理人于 2020 年 9 月 10 日发布的《关于国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国泰 CES 半导体芯片行业 ETF
场内简称	芯片 ETF
基金主代码	512760
交易代码	512760

基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 16 日
报告期末基金份额总额	12,161,322,772.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，基于本基金流动性管理的需要投资于政府债券、央行票据和金融债等固定收益类品种，以保证基金资产流动性，并降低组合跟踪误差。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p>

	<p>4、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> <p>5、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并积极利用正股和权证之间的不同组合来套取无风险收益。本基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，以追求较稳定的当期收益，并降低组合跟踪误差。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，参与股指期货的投资。此外，本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险。</p> <p>7、融资与转融通证券出借投资策略</p> <p>本基金在参与融资与转融通证券出借业务时，将通过对市场环境、利率水平、基金规模以及基金申购赎回情况等因素的研究和判断，决定融资规模与转融通证券出借业务的规模。本基金管理人将充分考虑融资与转融通证券出借业务的收益性、流动性及风险性特征，谨慎进行投资，提高基金的投资收益。</p>
业绩比较基准	中华交易服务半导体芯片行业指数收益率
风险收益特征	<p>本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金。</p> <p>本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中华</p>

	交易服务半导体芯片行业指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)
1. 本期已实现收益	1,471,415,054.27
2. 本期利润	-433,369,258.85
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0631
4. 期末基金资产净值	13,464,909,719.99
5. 期末基金份额净值	1.1072

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.63%	2.68%	-2.16%	2.70%	0.53%	-0.02%
过去六个月	29.22%	2.62%	28.83%	2.64%	0.39%	-0.02%
过去一年	71.67%	2.82%	70.99%	2.84%	0.68%	-0.02%

自基金合同生效起至今	121.44%	2.61%	117.47%	2.70%	3.97%	-0.09%
------------	---------	-------	---------	-------	-------	--------

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019 年 5 月 16 日至 2020 年 9 月 30 日)



注：本基金合同生效日为2019年5月16日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
艾小军	本基金的基金经理、	2019-04-02	-	19 年	硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006

	<p>国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰沪深 300 指数、国泰上证 180 金融 ETF、上证 10 年期国债 ETF、国泰黄金 ETF、国泰深证 TMT50 指数分级、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰国证航天军工指数 (LOF)、国泰策略价值灵活配置混合、国泰黄金 ETF 联接、国泰中证申万证券行业</p>				<p>年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金管理有限公司，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月起兼任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理，2017 年 5 月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金 (由国泰保本混合型证</p>
--	--	--	--	--	--

	<p>指数 (LOF)、国泰量化成长优选混合、上证 5 年期国债 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF 联接的基金经理、投资总监 (量化)、金融工程总监</p>				<p>券证券投资基金变更而来) 的基金经理, 2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2017 年 8 月起至 2019 年 5 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月起兼任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金 (由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来) 的基金经理, 2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金 (由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更而来) 的基金经理, 2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金 (由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来) 的基金经理, 2019 年 5 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金 (由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来) 的基金经理, 2019 年 7 月起兼任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指</p>
--	---	--	--	--	--



					数证券投资基金和国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2019 年 8 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2019 年 9 月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2017 年 7 月起任投资总监(量化)、金融工程总监。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金组合与其他投资组合之间，由于组合流动性管理或投资策略调整需要，参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 3 次。本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度在创业板注册制改革以及科创板推出一周年、科创板 50 指数正式推出等资本市场改革持续推进的背景下，市场风险偏好大幅提升，二季度末至 7 月中旬 A 股市场持续上扬，并创出年内新高。之后受新冠肺炎疫情持续蔓延，美国大选以及美国对华为的极限打压进而引起对 5G 建设低于预期的担忧等影响，包括 5G、消费电子等在内的半导体、通信板块持续回调，A 股市场在 3200 至 3400 区间震荡。受地缘政治影响，军队实战化训练加强，叠加补涨因素，军工行业表现突出。在海南离岛免税政策刺激下，免税主题持续走强。全季度来看，上证指数上涨 7.82%，大盘蓝筹股的表征指数如上证 50 上涨 9.87%，沪深 300 指数上涨 10.17%，成长性中小盘股表征指数如中证 500 上涨 5.59%，板块上科技股占比较多的中小板指上涨 8.19%，创业板指上涨 5.6%。

在行业表现上，申万一级行业中表现较好的休闲服务、军工、电气设备，涨幅分别为 32.97%、30.11%和 26.01%，表现落后的为通信、商业贸易、计算机，分别下跌了 8.10%、3.42%和 3.23%。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2020 年第三季度的净值增长率为-1.63%，同期业绩比较基准收益率为-2.16%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

四季度随着美国大选逐步明朗，大选期间的短期冲击将逐步消除，前期受到美国极限打压调整较多的半导体、通信等板块情绪有望修复；国内方面，十四五规划推进将对相关板块带来主题性的投资机会。随着秋冬季到来，新冠疫情二次冲击带来的政策对冲对整体市场流动性形成较为宽松的环境。受新冠疫情影响，得益于国内严格的防控措施，国内经济在全球经济体的吸引力更加凸显，有望带动外资加大 A 股资产的配置力度。

在中美科技竞争长期化的背景下，包括自主可控、国产替代有望带来包括半导体芯片、通信、计算机等行业的营收持续改善，相关领域公司的竞争力有望大幅提升。中长期我们仍

然看好受益于中国经济结构转型的消费龙头，受益医疗支出加大所带动的生物医药医疗，5G 等新基建领域的半导体、通信、计算机以及军工资产证券化和科研院所改制可能加速推进的军工。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	13,408,003,026.00	99.20
	其中：股票	13,408,003,026.00	99.20
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	91,411,108.95	0.68
7	其他各项资产	17,144,905.50	0.13
8	合计	13,516,559,040.45	100.00

注：1、上述股票投资包括可退替代款估值增值。

2、报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金参与转融通证

券出借业务借出股票的公允价值为441,220,129.00元。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,049,479.64	0.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00
F	批发和零售业	28,264.03	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	18,653.36	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,264,795.49	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	341,541.12	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	57,307.34	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	12,773,070.10	0.09

### 5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	13,179,349,314.69	97.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	24,033,048.21	0.18
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	191,850,867.00	1.42
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,395,233,229.90	99.48

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002049	紫光国微	9,017,038	1,071,043,773.64	7.95
2	603986	兆易创新	5,560,388	962,558,766.68	7.15
3	002129	中环股份	39,483,574	874,561,164.10	6.50
4	600584	长电科技	23,543,297	842,614,599.63	6.26
5	002371	北方华创	5,187,005	825,045,015.30	6.13
6	603501	韦尔股份	3,636,147	641,972,393.39	4.77
7	002185	华天科技	45,710,457	626,233,260.90	4.65
8	300661	圣邦股份	2,007,671	600,996,313.85	4.46
9	603160	汇顶科技	3,636,706	572,017,486.74	4.25

10	300782	卓胜微	1,156,950	437,095,710.00	3.25
----	--------	-----	-----------	----------------	------

### 5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002413	雷科防务	577,000	4,783,330.00	0.04
2	300999	金龙鱼	121,132	3,113,092.40	0.02
3	300183	东软载波	118,000	2,219,580.00	0.02
4	688520	神州细胞	12,351	688,321.23	0.01
5	688222	成都先导	9,201	341,541.12	0.00

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“中环股份”公告自身或分支机构违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

中环股份公司自身由于未及时披露公司与关联方发生的关联交易，受到深圳证券交易所监管关注等监管措施。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,808,688.18
2	应收证券清算款	10,812,646.36
3	应收股利	-
4	应收利息	523,570.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,144,905.50

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	----------------	--------------	----------

1	002049	紫光国微	43,307,188.00	0.32	转融通
2	603986	兆易创新	17,016,713.00	0.13	转融通
3	002129	中环股份	35,105,535.00	0.26	转融通
4	600584	长电科技	34,097,133.00	0.25	转融通
5	002371	北方华创	33,959,310.00	0.25	转融通
6	002185	华天科技	25,420,350.00	0.19	转融通
7	603501	韦尔股份	32,503,000.00	0.24	增发中签
8	603501	韦尔股份	11,564,524.00	0.09	转融通
9	300661	圣邦股份	12,063,805.00	0.09	转融通
10	603160	汇顶科技	24,584,427.00	0.18	转融通
11	300782	卓胜微	11,976,260.00	0.09	转融通

#### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	300999	金龙鱼	3,113,092.40	0.02	网下中签
2	688520	神州细胞	688,321.23	0.01	新股锁定
3	688222	成都先导	341,541.12	0.00	新股锁定

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	5,104,661,386.00
报告期基金总申购份额	14,729,661,386.00
减：报告期基金总赎回份额	7,673,000,000.00
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,161,322,772.00

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细



本报告期内，本基金的基金管理人未运用自有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	2020年07月14日至2020年07月16日，2020年07月23日至2020年08月04日，2020年08月06日至2020年09月30日	989,000.00	1,802,000.00	110,000.00	2,681,000.00	22.05%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

注：本基金本报告期内进行了拆分，本期申购份额包含了拆分增加的份额。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

本基金托管人住所。

### 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇二〇年十月二十八日